

Steve-TradingBot — Vollständige Auswertung seit Cutover

Datum: 2026-06-03 22:04 UTC (Snapshot) **Beobachtungsfenster:** 2026-05-31 12:22 UTC → 2026-06-03 22:04 UTC (≈ 81 h 42 min, ~3.4 Tage) **Bezugspunkt:** RangeTrading-V1 Cutover (commit 1ad93b5) **Bot Container:** Up 3 days (healthy) · 0 Tracebacks **Aktive Pipeline:** Legacy trading/main.py::run_scan_cycle **MS-Pipeline:** Shadow (MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=true)

🚨 1. KRITISCHES FINDING — Cash-Anomalie

State-Datei live_portfolio.json zeigt **cash = 0.00 USDT** seit **2026-06-03 14:50 UTC**.

Backup-Trajektorie:

Datum (00:xx UTC Backup)	Cash	Open Positions	Closed Trades
2026-05-31 (Cutover-Tag)	9 862.32	1	234
2026-06-01	8 324.14	5	249
2026-06-02	9 841.46	1	266
2026-06-03 (00:45 backup)	10 029.79	0	277
2026-06-03 14:50 (current)	0.00	0	280

Was zwischen 00:45 und 14:50 passiert ist: - 3 Closed Trades: MORPHO +0.31 · AVAX +0.42 · RENDER +0.35 = **+1.08 USDT** kombiniert - Erwarteter Cash: 10 029.79 + 1.08 ≈ **10 030.87 USDT** - Tatsächlich: **0.00 USDT** → Diskrepanz ≈ **10 031 USDT**

Konsequenz seit ~14:50: - Bot scannt weiter (Scan #1850+), evaluiert Kandidaten, aber **kann nicht kaufen** (cash = 0) - Seit 13:44:38 UTC kein einziger BUY mehr ausgeführt (~8 h Idle-Mode) - 0 Tracebacks · 0 errors im Log

Mögliche Ursachen: 1. Externe State-Edit (Operator oder Maintenance-Script) 2. Interner Bug im Cash-Accounting bei Outage-Recovery (vor 14:50 lief Binance-502-Cluster über 2 h) 3. Watchdog hat State reset

Empfehlung: SOFORT investigieren — als **EXIT-REASON-FIX-1**-vorgelagertes **STATE-CASH-RESET-1 (P0)** ins Backlog.

2. Aktive Pipeline — Trades seit Cutover (81 h)

2.1 Aggregat

Metrik	Wert
Total Closed Trades	41
Wins	27 (+33.57 USDT)
Losses	14 (-79.45 USDT)
Netto-PnL	-45.88 USDT
BUYs (gesamt)	28
PARTIAL Sells (E2a)	13
FULL Sells (B-E + Trailing + Fixed-SL)	28

2.2 Exit-Reason-Verteilung

Reason	Count	Charakter
break_even_stop	19	überwiegend positiv (E1a-Saves)
trailing_stop_profit	8	alle positiv
fixed_stop_loss	14	alle negativ

2.3 Top-Gewinner / Top-Verlierer

Gewinner Top 6:

Symbol	PnL	Setup
ENA/USDT (2026-06-02)	+8.02 USDT	E2a +1.28 + Trail +6.74 (+4.77 %) — größter Single-Trade
CHIP/USDT (2026-06-02 Re-Entry)	+4.61 USDT	E2a +1.31 + Trail +3.30

POLYX/USDT	+4.83 USDT	E2a +3.14 (+5.21 %) + Trail +1.69
PUMP/USDT	+3.64 USDT	E2a +1.80 + Trail +1.84
ICP/USDT (Run 1+2)	+3.75 USDT	Doppel-Setup in 30 min
DOGS/USDT (Run 1+2)	+4.62 USDT	beide E2a-Kaskaden

Verlierer Top 5:

Symbol	PnL	Reason
AAVE/USDT	-16.60 USDT	CORE-HIGH 821 USDT-Slot, als <code>break_even_stop</code> mit -2.02 % geflagged
TRUMP/USDT	-9.36 USDT	CORE-MID 301 USDT-Slot, Fixed-SL
ETHFI/USDT	-8.80 USDT	Fixed-SL nach nur 24 min
PNUT/USDT	-7.54 USDT	Fixed-SL nach 3 h 26 min
SHIB/USDT	-7.21 USDT	CORE-MID Fixed-SL

2.4 BEAR-Phase Cluster-Verlust (2026-06-02 14:19-14:27 UTC)

In 8 Minuten 4 SL-Hits: ETH -3.49 · PNUT -7.54 · ETHFI -8.80 · TRUMP -9.36 = **-29.19 USDT**. Risk-Guard hat in allen 4 Fällen DCA korrekt blockiert.

2.5 E1a / E2a / Risk-Guard-Wirkung

Mechanismus	Count	Wirkung
E1a Break-Even-Gain	19	17/19 Saves positiv, 2 als „B-E“ geflagged aber negativ (Misclassification)
E2a Partial-Profit	13	alle 13 positiv realisiert
Trailing-Stop-Profit	8	alle 8 positiv
Risk-Guard DCA-Block (BEAR)	≥ 10	wirkt korrekt
Fixed-SL	14	Capital-Preservation aktiv

2.6 Outage-Resilience Live-Probe (2026-06-03 11:03 → 13:37)

Binance-Testnet 502 Bad Gateway für ~2 h 30 min: ~36 fehlgeschlagene Partial+Full-Sell-Versuche auf RENDER + AVAX - Circuit-Breaker korrekt geöffnet, OP/USDT BUY pausiert - P0-Fix-1 Pending-Marker-Rollback wirkte konsistent - Recovery: AVAX +0.42 + RENDER +0.77 partial +0.35 rest — alle final profitabel geschlossen - **0 Phantom-Sells, 0 Double-Sells, 0 State-Korruption** beobachtet während Outage

2.7 Re-Entry-Patterns (interessant)

Symbol	Anzahl Runs	Total PnL
DOGS/USDT	2	+4.62
ICP/USDT	3	+2.76 (Run 1 +2.24, Run 2 +1.51, Run 3 -0.99)
RENDER/USDT	3	+2.80 (über 3 Tage verteilt)
NEAR/USDT	2	+1.91
CHIP/USDT	2	+5.75

Repeat-Cooldown nach Profit-Closes (trailing/B-E) wird **nicht** gesetzt — by design. Re-Entry passiert manchmal innerhalb 16 s.

3. MS-Dry-Run — Strategy-Activity (81 h)

3.1 Evaluation-Volumen

Strategy	Evaluations	TRADE_CANDIDATEs	Conversion
trend_follow	8 154	291	3.57 %
oversold_bounce	5 592	0	0 %
breakout	2 953	0	0 %
vwap_mean_reversion	2 642	0	0 %
volatility_sweep	2 642	3	0.11 %

mean_reversion (RangeTrading-V1)	2 642	0	0 %
Σ	24 625	294	1.19 %

3.2 trend_follow Candidates (291) — Symbol-Verteilung

Symbol	Count
TON/USDT	45
ICP/USDT	41
NEAR/USDT	36
FET/USDT	30
POL/USDT	29
WLD/USDT	26
TRUMP/USDT	19
PUMP/USDT	14
EPIC/USDT	11
ALLO/USDT	10
XPL/USDT	7
MEME/USDT	7
XLM/USDT	6
ALGO/USDT	6
APE/USDT	4
RENDER/USDT	3

Top 4 Symbole = 152 / 291 ≈ 52 % der Candidates. Wenn MS-Live aktiviert wäre, würde TON 45× neu gekauft werden — REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1 wäre Pflicht.

3.3 volatility_sweep — 3 Candidates (NEU seit letztem Report unverändert)

Alle 3 = ICP/USDT in RANGE-Regime am 2026-05-31 21:54-21:59 UTC, final_score 9.045.

3.4 RangeTrading-V1 (mean_reversion) — Reject-Pattern

2 642 Evaluations, 0 Candidates in 81 h.

#	Reject-Reason	Anteil
1 837	Price in range middle (range_position > 0.40)	69.5 %
499	Range width too small (< 1.5 % UND < 1.5 × ATR)	18.9 %
202	Risk/reward below 2.0	7.6 %
73	Support broken without reclaim	2.8 %
31	No valid S/R cluster	1.2 %

Verdict: Strategie wartet diszipliniert. Score-Cutoff 6.0 ist sinnvoll, **keine Lockerung empfohlen** bis ≥ 5 Tage Beobachtung. RR<2.0-Rejects bei 7.6 % zeigen, dass die TP=range_high × 0.998 Logik den Min-RR-Filter scharf hält.

3.5 OversoldBounce — Reject-Pattern

5 592 Evaluations, 0 Candidates. 100 % wegen RSI not oversold enough (need <25 OR <30+reversal) . Markt-Zustand bot in 81 h keine echten Boden-Extreme.

3.6 Legacy vs MS — Overlap

Legacy hat 32 verschiedene Coins gehandelt. MS-Candidates auf 16 Coins. **Overlap: 11 Coins** (ALGO, FET, ICP, MEME, NEAR, PUMP, RENDER, TRUMP, WLD, XLM, XPL).

5 MS-Candidate-Symbole wurden Legacy NICHT gehandelt (TON 45×, POL 29×, EPIC 11×, ALLO 10×, APE 4×) — das wären komplementäre MS-Live-Signale.

4. P1-Findings live mehrfach bestätigt

4.1 LABEL-1 Exit-Reason Misclassification (3x live reproduziert)

Trade	Reason-Tag	Realer PnL	Realer Charakter
AAVE/USDT (2026-06-01)	break_even_stop	-16.60 USDT	Fixed-SL hit
RIF/USDT (2026-06-02)	break_even_stop	-0.62 USDT	nach E1a, aber Exit unter B-E-SL
ICP/USDT Run 3 (2026-06-02)	break_even_stop	-0.99 USDT	nach E1a, Exit 0.4 % unter B-E-SL

Operator-Statistik wird verfälscht: der Anteil „break_even_stop“ wird optisch besser als die Realität.

4.2 CORE-Slot-Risk-Konzentration

Slot-Tier	Anzahl Loser	Total Loss
CORE-HIGH (821 USDT)	1 (AAVE)	-16.60 USDT
CORE-MID (301 USDT)	2 (TRUMP, SHIB)	-16.57 USDT
OPPORTUNISTIC (200 USDT)	11	-46.28 USDT

Die 3 CORE-Trades verlieren -33.17 USDT (= 72 % des Loss-Totals von 79.45) bei nur 21 % der Closes (3 von 14).

5. Empfehlungen / Backlog

#	Item	Prio	Status
1	STATE-CASH-RESET-1 — Cash=0 Anomalie investigieren	P0	NEU heute
2	EXIT-REASON-FIX-1 — LABEL-1 Misclassification	P1	3x live reproduziert
3	CORE-SLOT-RISK-LIMIT-1 — High/Mid-Slot Reduktion in BEAR	P2	live verifiziert
4	MS-STABLECOIN-BLOCK-1 — USDE/EUR aus MS-RangeTrading	P3	EUR 51x evaluiert
5	REPEAT-CANDIDATE-DEDUP-1 — Pflicht vor MS-Live	P3	TON 45x Repeat
6	STRAT-RECON-PHASE-2 — Cooldown-Recovery R3+R4	P2	wartet

6. Empfohlene Code-Reihenfolge

1. **STATE-CASH-RESET-1 (P0)** — sofort investigieren: state-edit, bug, oder Operator-Aktion?
2. **EXIT-REASON-FIX-1 (P1)** — LABEL-1-classify-Logik defensiv prüfen: SL-Trigger-Preis vs `_sl_kind`-Tag konsistent machen
3. **CORE-SLOT-RISK-LIMIT-1 (P2)** — in BEAR-Regime keine CORE-HIGH/MID-Slots erlauben
4. Erst **dann** MS-Live-Vorbereitung (Repeat-Dedup, Stablecoin-Block)

7. Bot Health Snapshot

- Container Up 3 days (healthy)
- 0 Tracebacks in 81 h
- Outage-Resilience-Live-Test bestanden
- `BINANCE_TESTNET=true` · `MULTI_STRATEGY_DRY_RUN=true` · `LIVE_TRADING_ENABLED=true`
- **ABER:** Cash=0 seit 14:50 UTC → effektiv Idle-Mode (keine BUYs möglich)

8. STOP / GO

STOP. Operator-Decision empfohlen:

- **A** STATE-CASH-RESET-1 sofort als P0-Phase starten (Plan-vor-Code) — bot bleibt im Idle-Mode bis Cash wieder verfügbar
- **B** EXIT-REASON-FIX-1 parallel planen (Cash-Anomalie blockiert nur BUYs, nicht SELLs)
- **C** Anderes (z.B. Cash manuell wiederherstellen + dann investigieren)

Default-Empfehlung: **A + B parallel** — Cash-Anomalie ist Stop-the-line, Misclassification ist Operator-Trust-Issue.